

**华安信用四季红债券型证券投资基金**  
**2016 年年度报告摘要**  
**2016 年 12 月 31 日**

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年三月二十八日

## §1 重要提示

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	华安信用四季红债券
基金主代码	040026
交易代码	040026
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 12 月 8 日
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,346,052,557.62 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以信用债券为主要投资对象，在合理控制信用风险的基础上谨慎投资，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势，将规范化的基本面研究、严谨的信用分析与积极主动的投资风格相结合，在分析和判断宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上，动态调整大类金融资产比例，自上而下决定债券组合久期及债券类属配置；在严谨深入的信用分析基础上，综合考量信用债券的信用评级，以及各类债券的流动性、供求关系和收益率水平等，自下而上地精选个券。
业绩比较基准	中债企业债总指数收益率×65%+中债国债总指数收益率×35%
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中较低风险的品种，其预期的风险收益水平低于股票基金和混合基金，高于货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华安基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露	姓名	钱鲲	郭明

负责人	联系电话	021-38969999	010-66105799
	电子邮箱	qiankun@huaan.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008850099	95588
传真		021-68863414	010-66105798

## 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告摘要的管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金年度报告备置地点	上海市世纪大道 8 号上海国金中心二期 31、32 层

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016 年	2015 年	2014 年
本期已实现收益	64,530,262.38	55,913,696.00	68,583,387.92
本期利润	38,499,896.60	84,631,684.91	120,604,406.46
加权平均基金份额本期利润	0.0291	0.1097	0.0724
本期基金份额净值增长率	2.90%	12.80%	7.34%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配基金份额利润	0.0201	0.0306	0.0042
期末基金资产净值	1,435,557,523.09	1,388,743,650.26	600,764,732.93
期末基金份额净值	1.066	1.095	1.022

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.66%	0.06%	-4.09%	0.17%	3.43%	-0.11%
过去六个月	0.83%	0.06%	-3.41%	0.13%	4.24%	-0.07%
过去一年	2.90%	0.06%	-5.55%	0.11%	8.45%	-0.05%
过去三年	24.59%	0.10%	3.02%	0.11%	21.57%	-0.01%
过去五年	37.63%	0.09%	0.25%	0.10%	37.38%	-0.01%
自基金合同生效起至今	37.90%	0.09%	0.28%	0.10%	37.62%	-0.01%

注：本基金业绩比较基准：中债企业债总指数收益率×65%+中债国债总指数收益率×35%

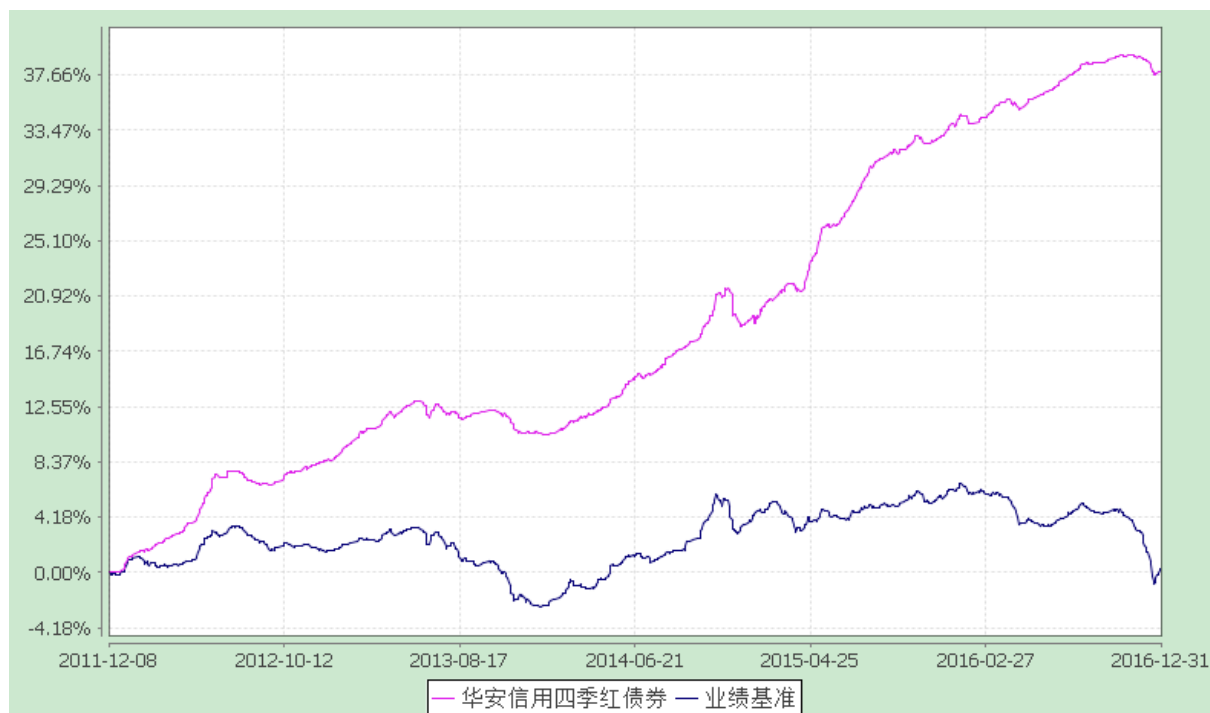
根据基金合同的有关规定，本基金为债券型基金，主要投资于固定收益类资产，包括国债、中央银行票据、地方政府债、中期票据、金融债、企业债、公司债、短期融资券、可转债、分离交易可转债、资产支持证券、次级债、债券回购、期限在一年期以内的定期存款等。本基金不投资股票，也不直接在二级市场买入可转债和权证，但可以参与一级市场可转债的申购，并可持有因投资分离交易可转债而产生的权证。本基金投资比例限制为：投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产净值的 80%，其中对信用债券的投资比例不低于固定收益类资产的 80%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；权证的投资比例不超过基金资产净值的 3%。

#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安信用四季红债券型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

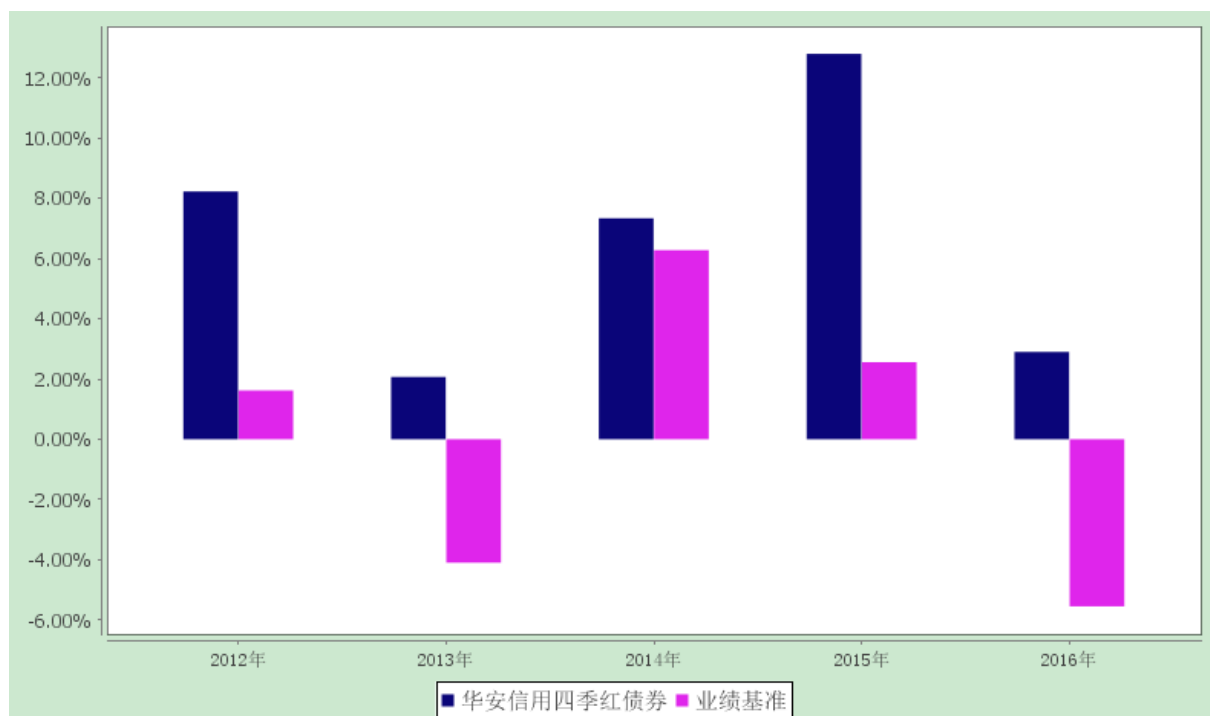
(2011 年 12 月 8 日至 2016 年 12 月 31 日)



### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华安信用四季红债券型证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2016年	0.600	55,897,726.82	21,146,338.89	77,044,065.71	-
2015年	0.550	41,418,906.69	2,716,090.50	44,134,997.19	-
2014年	0.530	48,793,891.68	3,185,711.77	51,979,603.45	-
合计	1.680	146,110,525.19	27,048,141.16	173,158,666.35	-

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华安基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]20号文批准于1998年6月设立，是国内首批基金管理公司之一，注册资本1.5亿元人民币，公司总部设在上海陆家嘴金融贸易区。目前的股东为上海电气（集团）总公司、上海国际信托有限公司、上海工业投资（集团）有限公司、上海锦江国际投资管理有限公司和国泰君安投资管理股份有限公司。

截至2016年12月31日，公司旗下共管理华安创新混合、华安中国A股增强指数、华安现金富利货币、华安宝利配置混合、华安宏利混合、华安中小盘成长混合、华安策略优选混合、华安核心优选混合、华安稳定收益债券、华安动态灵活混合、华安强化收益债券、华安行业轮动混合、华安上证180ETF、华安上证180ETF联接、华安上证龙头ETF、华安上证龙头ETF联接、华安升级主题混合、华安稳固收益债券、华安可转债、华安深证300指数（LOF）、华安科技动力混合、华安信用四季红债券、华安香港精选股票、华安大中华升级股票、华安标普石油指数基金（QDII-LOF）、华安月月鑫短期理财债券、华安季季鑫短期理财债券、华安月安鑫短期理财债券、华安沪深300指数分级、华安逆向策略混合、华安日日鑫货币、华安安心收益债券、华安信用增强债券、华安纯债、华安保本混合、华安双债添利债券、华安安信消费混合、华安纳斯达克100指数、华安黄金易ETF、华安黄金ETF联接、华安沪深300量化增强、华安年年红债券、华安生态优先混合、华安中证细分医药ETF、华安大国新经济股票、华安新活力混合、华安安顺灵活配置混合、华安汇财通货币、华安国际龙头（DAX）ETF、华安国际龙头（DAX）ETF联接、华安中证细分医药ETF联接、华安安享灵活配置混合、华安年年盈定期开放债券、华安物联网主题股票、华安新丝路主题股票、华安新动力灵活配置混合、华安智能装备主题股票、华安媒体互联网混合、华安新机遇保本混合、华安新优选灵活配置混合、华安新回报灵活配置混合、华安中证全指证券指数分级、华

安中证银行指数分级、华安国企改革主题混合、华安添颐养老混合发起式、华安创业板 50 指数分级、华安新乐享保本混合、华安安益保本混合、华安乐惠保本混合、华安安康保本混合、华安安华保本混合、华安沪港深外延增长混合、华安全球美元收益债券、华安安禧保本混合、华安全球美元票息债券、华安创业板 50ETF、华安安进保本混合发起式、华安聚利 18 个月定开债、华安智增精选灵活配置混合、华安新财富灵活配置混合、华安安润灵活配置混合、华安睿享定开混合发起式、华安新希望灵活配置混合、华安鼎丰债券发起式、华安新瑞利灵活配置混合、华安新泰利灵活配置混合、华安新恒利灵活配置混合、华安事件驱动量化策略混合、华安新丰利灵活配置混合等 89 只开放式基金。管理资产规模达到 1632.85 亿元人民币。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限		证券从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
苏玉平	本基金的基金经理	2011-12-08	-	19 年	货币银行硕士，19 年证券、基金行业从业经历。曾任海通证券有限责任公司投资银行部项目经理；交通银行托管部内控监察和市场拓展部经理；中德安联保险有限公司投资部部门经理；国联安基金管理有限公司基金经理。2011 年 2 月加入华安基金管理有限公司。2011 年 7 月起担任华安强化收益债券基金的基金经理；2011 年 12 月起同时担任本基金的基金经理；2013 年 2 月起担任华安纯债债券型发起式证券投资基金的基金经理。2013 年 11 月起同时担任华安年年红定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2014 年 4 月起同时担任华安新活力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015 年 1 月起担任华安安享灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 9 月起，同时担任华安新财富灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
石雨欣	本基金的基金经理	2015-07-17	-	10 年	硕士研究生，10 年相关行业从业经验，曾任联合资信评估有限公



				<p>司高级分析师。2008 年 1 月加入华安基金管理有限公司，任固定收益部信用分析师。2015 年 7 月起担任本基金及华安稳固收益债券型证券投资基金的基金经理。2016 年 2 月起担任华安安康保本混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 8 月起同时担任华安聚利 18 个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2016 年 12 月起，同时担任华安新恒利灵活配置混合型证券投资基金、华安新瑞利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	---

注：此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日，即以公告日为准。证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》，将封闭式基金、开放式基金、特定客户资产管理组合及其他投资组合资产在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括：在研究环节，研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中，使用晨会发言、邮件发送、登录在研究报告管理系统中等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节，公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略，制定并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节，公司实行强制公平交易机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。（1）交易所二级市场业务，遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则，实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。（2）交易所一级市场业务，投

投资组合经理按意愿独立进行业务申报，集中交易部以投资组合名义对外进行申报。若该业务以公司名义进行申报与中签，则按实际中签情况以价格优先、比例分配原则进行分配。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在合规监察员监督参与下，进行公平协商分配。

(3) 银行间市场业务遵循指令时间优先原则，先到先询价的控制原则。通过内部共同的 iwind 群，发布询价需求和结果，做到信息公开。若是多个投资组合进行一级市场投标，则各投资组合经理须以各投资组合名义向集中交易部下达投资意向，交易员以此进行投标，以确保中签结果与投资组合投标意向一一对应。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在风险管理部投资监督参与下，进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节，公司风险管理部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上市交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，根据市场公认的第三方信息（如：中债登的债券估值），定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合，在不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）的本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司合规监察稽核部会同基金投资、交易部门讨论制定了公募基金、专户针对股票、债券、回购等投资品种在交易所及银行间的同日反向交易控制规则，并在投资系统中进行了设置，实现了完全的系统控制。同时加强了对基金、专户间的同日反向交易的监控与隔日反向交易的检查；风险管理部开发了同向交易分析系统，对相关同向交易指标进行持续监控，并定期对组合间的同向交易行为进行了重点分析。

本报告期内，因组合流动性管理或投资策略调整需要，除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的次数为 9 次，未出现异常交易。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年经济基本面相对较为平稳，四个季度经济增速均维持 6.7%，但经济结构和微观企业发生了较大变化，供给侧改革使得工业企业盈利大幅回升，投资增速也止跌企稳，第三产业对经济的推动力进一步加大。海外经济变化较大，英国脱欧、美联储加息和特朗普上台等一系列因素使得美元维持强势地位，人民币由于国内资产价格高企而产生较强的贬值压力，外汇占款持续减少，对基础货币造成明显的冲击。央行通过 MLF 和公开市场操作进行对冲，维持国内流动性稳定。虽然经济和货币总量相对平稳，但债券市场收益率却遭受了巨大的波动，主要事件是 4 月份的信用危机和 12 月的流动性危机。整体来看，债券市场在 2016 年呈现宽幅震荡、牛长熊短的走势。

报告期内，本基金在去年大部分时间维持低杠杆运作，将防信用风险和流动性风险放在较为突出的位置，因此受到市场冲击相对较小，在守住绝对收益果实的同时，也取得了较好的相对收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.066 元，本报告期份额净值增长率为 2.90%，同期业绩比较基准增长率为-5.55%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017 年影响债券市场的不确定因素进一步增加。首先，欧洲政治和经济的黑天鹅事件将不定期地刺激市场神经，例如苏格兰“脱欧”、法国、意大利、德国和荷兰大选等。近期我们也可以看到，德国国债收益有较为明显的下行，黄金价格逐步走强，市场避险需求显著增加。其次，特朗普的减税和基建计划落实情况存在不确定性，不仅会直接影响到美国经济前景，也可能改变美联储加息进程。

国内方面，经济总体缓中趋稳，稳中向好，随着供给侧改革的逐步推进，工业企业盈利状况逐步好转，基建和地产依然是支撑经济的重要力量。央行货币政策定调稳健中性，在保持总量平稳的情况下，强化价格调控和预期引导，我们认为货币政策在边际上仍有进一步收紧的空间，不排除有继续上调 MLF 和 OMO 市场利率的可能。同时，金融监管也将进一步加强，不仅有针对银行的 MPA 考核，还有针对资管行业的一系列监管。此外，通胀有所抬头，但有一部分是去年低基数原因造成，能否进一步上行还有待观察，尤其需要关注农产品和油价的走势。综合以上几点，我们判断短期债券市场仍将承压，流动性也会出现阶段性紧张。尤其是今年 3 月，MPA 考核首次将表外理财纳入广义信贷，部分中小银行的表外业务在 2016 年大幅扩张，将会面临监管压力。

2017 年信用债市场会出现一定的分化。由于供给侧改革进一步深入，相当一部分的行业尤其是落后产能行业的集中度明显提升，行业龙头企业的地位得到进一步巩固，但缺乏竞争优势的企业将难免遭遇淘汰，因此信用利差可能会逐步拉大。在央行货币政策收紧的同时，中小企业的融资难

度加大，成本上升，有可能会出现局部违约事件。

本基金仍将以短久期、高等级信用债为首选配置品种，降低信用风险和利率风险，利用 MPA 考核时点的阶段性机会进行积极布局。若下半年经济出现疲态，央行货币政策在边际上有所放松，择机拉长组合久期提高收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

##### 1、估值政策及重大变化

无。

##### 2、估值政策重大变化对基金资产净值及当期损益的影响

无。

##### 3、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

###### (1) 公司方面

公司建立基金估值委员会，组成人员包括：基金投资部兼全球投资部高级总监、投资研究部高级总监、固定收益部总监、指数投资部高级总监、基金运营部总经理及相关负责人员。

主要职责包括：证券发行机构发生了严重影响证券价格的重大事件时，负责评估重大事件对投资品种价值的影响程度、评估对基金估值的影响程度、确定采用的估值方法、确定该证券的公允价值；同时将采用确定的方法以及采用该方法对相关证券估值后与基金的托管银行进行沟通。

相关人员专业胜任能力及工作经历：

翁启森，基金投资部兼全球投资部高级总监，总经理助理，工业工程学硕士。曾在台湾 JP 证券任金融产业分析师及投资经理，台湾摩根富林明投信投资管理部任基金经理，台湾中信证券投资总监助理，台湾保德信投信任基金经理。2008 年 4 月加入华安基金管理有限公司，现任华安香港精选股票、华安大中华升级股票、华安大国新经济股票、华安物联网主题股票的基金经理，华安基金管理有限公司总经理助理、基金投资部兼全球投资部高级总监。

杨明，投资研究部高级总监，研究生学历。曾在上海银行从事信贷员、交易员及风险管理。2004 年 10 月进入华安基金管理有限公司，担任研究发展部宏观研究员，现任华安策略优选混合、华安沪港深外延增长混合、华安安禧保本的基金经理，投资研究部高级总监。

贺涛，金融学硕士，固定收益部总监。曾任长城证券有限责任公司债券研究员，华安基金管理有限公司债券研究员、债券投资风险管理员、固定收益投资经理。现任华安现金富利货币、华安稳

定收益债券、华安可转债、华安月月鑫短期理财、华安季季鑫短期理财、华安月安鑫短期理财、华安信用增强债券、华安双债添利债券、华安汇财通货币、华安年年盈定期开放式债券、华安新回报灵活配置、华安新乐享保本、华安乐惠保本、华安安华保本、华安安进保本、华安新希望混合、华安睿享定开混合的基金经理，固定收益部总监。

许之彦，指数投资部高级总监，理学博士，CQF(国际数量金融工程师)。曾在广发证券和中山大学经济管理学院博士后流动站从事金融工程工作，2005 年加入华安基金管理有限公司，曾任研究发展部数量策略分析师，现任华安上证 180ETF 及华安上证 180ETF 联接、华安深证 300 指数 (LOF)、华安易富黄金 ETF 及联接、华安中证全指证券公司指数分级、华安中证银行指数分级、华安创业板 50 指数分级、华安创业板 50ETF 的基金经理，指数投资部高级总监。

陈林，基金运营部总经理，工商管理硕士，高级会计师，CPA 中国注册会计师协会非执业会员。曾在安永大华会计师事务所工作，2004 年 11 月加入华安基金管理有限公司，曾任财务核算部副总监、公司财务部总经理，现任基金运营部总经理。

## (2) 托管银行

托管银行根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任，并且认真核查公司采用的估值政策和程序。

## (3) 会计师事务所

对相关估值模型、假设及参数的适当性出具审核意见和报告。

## 4、基金经理参与或决定估值的程度

本基金的基金经理未参与基金的估值。

## 5、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

## 6、已签约的任何定价服务的性质与程度等信息

无。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内实施了 2015 年度第四次分红及 2016 年度的三次分红，并于期后公告了 2016 年度第四次分红方案。

2015 年度第四次分红，分红方案为：0.25 元/10 份。权益登记日、除息日：2016 年 1 月 20 日；现金红利发放日：2016 年 1 月 21 日。

2016 年度第一次分红，分红方案为：0.10 元/10 份。权益登记日、除息日：2016 年 4 月 20 日；现金红利发放日：2016 年 4 月 21 日。

2016 年度第二次分红，分红方案为：0.14 元/10 份。权益登记日、除息日：2016 年 7 月 19 日；现金红利发放日：2016 年 7 月 20 日。

2016 年度第三次分红，分红方案为：0.11 元/10 份。权益登记日、除息日：2016 年 10 月 25 日；现金红利发放日：2016 年 10 月 26 日。

本基金的基金管理人于 2017 年 1 月 17 日发布 2016 年度第四次分红公告：0.19 元/10 份。权益登记日及除息日：2017 年 1 月 19 日；现金红利发放日：2017 年 1 月 20 日。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金报告期内不存在基金持有人数低于 200 人或基金资产净值低于 5000 万元的情形。

### §5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对华安信用四季红债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，华安信用四季红债券型证券投资基金的管理人——华安基金管理有限公司在华安信用四季红债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，华安信用四季红债券型证券投资基金对基金份额持有人进行了 4 次利润分配，分配金额为 77,044,065.71 元。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对华安基金管理有限公司编制和披露的华安信用四季红债券型证券投资基金 2016 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## §6 审计报告

本报告期的基金财务会计报告经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计，注册会计师单峰 张振波签字出具了普华永道中天审字(2017)第 20250 号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：华安信用四季红债券型证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：	-	-
银行存款	50,472,491.95	56,127,293.95
结算备付金	2,396,191.31	6,877,497.47
存出保证金	1,819.01	8,878.21
交易性金融资产	1,205,125,539.10	1,852,422,181.84
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	1,205,125,539.10	1,852,422,181.84
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	173,100,792.65	-

应收证券清算款	-	-
应收利息	24,949,470.48	38,598,412.67
应收股利	-	-
应收申购款	43,201.71	490,110.37
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
<b>资产总计</b>	<b>1,456,089,506.21</b>	<b>1,954,524,374.51</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2016 年 12 月 31 日</b>	<b>2015 年 12 月 31 日</b>
负 债:	-	-
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	554,499,374.50
应付证券清算款	18,354,884.22	9,002,907.03
应付赎回款	667,939.30	770,234.84
应付管理人报酬	907,299.84	821,016.60
应付托管费	259,228.54	234,576.13
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	22,631.22	18,590.89
应交税费	-	-
应付利息	-	139,524.26
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	320,000.00	294,500.00
<b>负债合计</b>	<b>20,531,983.12</b>	<b>565,780,724.25</b>
<b>所有者权益:</b>	-	-
实收基金	1,346,052,557.62	1,268,577,164.64
未分配利润	89,504,965.47	120,166,485.62



所有者权益合计	1,435,557,523.09	1,388,743,650.26
负债和所有者权益总计	1,456,089,506.21	1,954,524,374.51

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.066 元，基金份额总额 1,346,052,557.62 份。

## 7.2 利润表

会计主体：华安信用四季红债券型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	<b>54,663,817.04</b>	<b>108,687,441.97</b>
1.利息收入	71,282,106.66	72,896,048.26
其中：存款利息收入	255,840.25	294,344.56
债券利息收入	69,259,720.00	72,521,575.91
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	1,766,546.41	80,127.79
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	4,707,098.52	5,168,555.48
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	4,707,098.52	5,168,555.48
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-26,030,365.78	28,717,988.91
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	4,704,977.64	1,904,849.32
<b>减：二、费用</b>	<b>16,163,920.44</b>	<b>24,055,757.06</b>
1. 管理人报酬	9,973,545.73	5,772,337.71
2. 托管费	2,849,584.51	1,649,239.27
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	37,394.56	19,657.39
5. 利息支出	2,921,136.39	16,252,138.38
其中：卖出回购金融资产支出	2,921,136.39	16,252,138.38
6. 其他费用	382,259.25	362,384.31
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>38,499,896.60</b>	<b>84,631,684.91</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>38,499,896.60</b>	<b>84,631,684.91</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安信用四季红债券型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,268,577,164.64	120,166,485.62	1,388,743,650.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	38,499,896.60	38,499,896.60
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	77,475,392.98	7,882,648.96	85,358,041.94

其中：1.基金申购款	638,973,652.79	50,005,141.13	688,978,793.92
2.基金赎回款	-561,498,259.81	-42,122,492.17	-603,620,751.98
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-77,044,065.71	-77,044,065.71
五、期末所有者权益（基金净值）	1,346,052,557.62	89,504,965.47	1,435,557,523.09
项目	上年度可比期间		
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	588,046,447.24	12,718,285.69	600,764,732.93
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	84,631,684.91	84,631,684.91
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	680,530,717.40	66,951,512.21	747,482,229.61
其中：1.基金申购款	951,269,831.82	84,623,522.16	1,035,893,353.98
2.基金赎回款	-270,739,114.42	-17,672,009.95	-288,411,124.37
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-44,134,997.19	-44,134,997.19
五、期末所有者权益（基金净值）	1,268,577,164.64	120,166,485.62	1,388,743,650.26

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：朱学华，主管会计工作负责人：章国富，会计机构负责人：陈林

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

华安信用四季红债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2011]第 1690 号《关于核准华安信用四季红债券型证券投资基金募集的批复》核准，由华安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安信用四季红债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 536,605,037.48 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第 476 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华安信用四季红债券型证券投资基金基金合同》于 2011 年 12 月 8 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 536,655,350.13 份基金份额，其中认购资金利息折合 50,312.65 份基金份额。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安信用四季红债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行和上市的债券、货币市场工具、资产支持证券、权证及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金主要投资于固定收益类资产，包括国债、中央银行票据、地方政府债、中期票据、金融债、企业债、公司债、短期融资券、可转债、分离交易可转债、资产支持证券、次级债、债券回购、期限在一年期以内的定期存款等。本基金不投资股票，也不直接在二级市场买入可转债和权证，但可以参与一级市场可转债的申购，并可持有因投资分离交易可转债而产生的权证。本基金投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%，其中对信用债券的投资比例不低于固定收益类资产的 80%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；权证的投资比例不超过基金资产净值的 3%。本基金的业绩比较基准为：中债企业债总指数收益率×65%+中债国债总指数收益率×35%。

本财务报表由本基金的基金管理人华安基金管理有限公司于 2017 年 3 月 24 日批准报出。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准

则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称企业会计准则)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《 华安信用四季红债券型证券投资基金 基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年度财务报表符合企业会计准则的要求, 真实、完整地反映了本基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期及上年度可比期间无须说明的会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、及其他相关财税法规和实务操作, 主要税项列示如下:

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前, 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围, 不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起, 金融业

由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

#### 7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华安基金管理有限公司(“华安基金公司”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“工商银行”)	基金托管人、基金代销机构
上海国际信托有限公司	基金管理人的股东
上海电气(集团)总公司	基金管理人的股东
上海工业投资(集团)有限公司	基金管理人的股东
上海锦江国际投资管理有限公司	基金管理人的股东
国泰君安投资管理股份有限公司	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.8.1.1 股票交易

无。

###### 7.4.8.1.2 权证交易

无。

###### 7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

无。

##### 7.4.8.2 关联方报酬

###### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	9,973,545.73	5,772,337.71
其中：支付销售机构的客户维护费	691,387.00	318,214.56

注：支付基金管理人华安基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.70% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.70\% / \text{当年天数}。$$

#### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,849,584.51	1,649,239.27

注：支付基金托管人工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}。$$

#### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.8.4.1 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

##### 7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
-------	----	---------

	2016年1月1日至2016年12月31日		2015年1月1日至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	25,472,491.95	160,672.07	56,127,293.95	160,439.23

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.9 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

##### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

无。

###### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

###### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。



第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为 1,205,125,539.10 元，无属于第一层次和第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第二层次 1,852,422,181.84 元，无第一层次和第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2015 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	1,205,125,539.10	82.76
	其中：债券	1,205,125,539.10	82.76
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	173,100,792.65	11.89
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	52,868,683.26	3.63
7	其他各项资产	24,994,491.20	1.72
8	合计	1,456,089,506.21	100.00

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细

本基金本报告期末未买入股票。

**8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细**

本基金本报告期末未卖出股票。

**8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额**

无。

**8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合**

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	19,987,000.00	1.39
2	央行票据	-	-
3	金融债券	50,233,000.00	3.50
	其中：政策性金融债	50,233,000.00	3.50
4	企业债券	523,974,539.10	36.50
5	企业短期融资券	610,931,000.00	42.56
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,205,125,539.10	83.95

**8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细**

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	041664002	16 武清国资 CP001	500,000	50,310,000.00	3.50
2	011699710	16 华电 SCP007	500,000	50,150,000.00	3.49
3	011699960	16 京能洁能 SCP004	500,000	50,075,000.00	3.49

4	122665	PR 镇交投	749,690	46,030,966.00	3.21
5	122299	13 中原债	400,000	41,844,000.00	2.91

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期没有投资贵金属。

### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期没有投资股指期货。

#### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 本期国债期货投资政策

无。

#### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期没有投资国债期货。

#### 8.11.3 本期国债期货投资评价

无。

### 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.12.2 本基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

#### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,819.01
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	24,949,470.48
5	应收申购款	43,201.71
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	24,994,491.20

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### §9 基金份额持有人信息

#### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
20,010	67,268.99	1,110,381,420.00	82.49%	235,671,137.70	17.51%

#### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
----	-----------	----------

基金管理人所有从业人员持有本基金	1,989.05	0.00%
------------------	----------	-------

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 0；

本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2011 年 12 月 8 日)基金份额总额	536,655,350.13
本报告期期初基金份额总额	1,268,577,164.64
本报告期基金总申购份额	638,973,652.79
减：本报告期基金总赎回份额	561,498,259.81
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,346,052,557.62

注：总申购份额含红利再投、转换入份额。总赎回份额含转换出份额。

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

无。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金财产、基金托管业务的诉讼。报告期内基金管理人无涉及本基金财产的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内无基金投资策略的改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

报告年度应支付给聘任会计师事务所的报酬情况：80,000.00 元。

目前的审计机构已提供审计服务的连续年限：自 2007 年 6 月 5 日起至今。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
宏信证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
上海证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
中天证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
广发华福	1	-	-	-	-	-
上海华信	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-

国信证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-

注：1、券商专用交易单元选择标准：

基金管理人负责选择证券经营机构，选用其交易单元供本基金证券买卖专用，选择标准为：

- (1) 内部管理规范、严谨；具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (2) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能够针对本基金业务需要，提供高质量的研究报告和较为全面的服务；
- (3) 具有战略规划和定位，能够积极推动多边业务合作，最大限度地调动整体资源，为基金投资赢取机会；
- (4) 其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

2、券商专用交易单元选择程序：

(1) 对交易单元候选券商的综合服务进行评估

由相关部门牵头并组织有关人员依据上述交易单元选择标准和《券商服务评价办法》，对候选交易单元的券商服务质量和综合实力进行评估。

(2) 填写《新增交易单元申请审核表》

牵头部门汇总对各候选交易单元券商的综合评估结果，择优选出拟新增单元，填写《新增交易单元申请审核表》，对拟新增交易单元的必要性和合规性进行阐述。

(3) 候选交易单元名单提交分管副总经理审批

公司分管副总经理对相关部门提交的《新增交易单元申请审核表》及其对券商综合评估的结果进行审核，并签署审批意见。

(4) 协议签署及通知托管人

基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元租用协议》，并通知基金托管人。

3、报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

2016 年 4 月完成租用托管在工商银行的西藏东方财富证券深圳 395395 交易单元

2016 年 8 月完成租用托管在工商银行的天风证券深圳 398013 交易单元

2016 年 11 月完成租用托管在工商银行的宏信证券深圳 002331 深圳交易单元



11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中泰证券	-	-	77,846,000.00	1.87%	-	-
上海证券	244,106,033.60	52.80%	-	-	-	-
华泰证券	-	-	12,000,000.00	0.29%	-	-
广发证券	531,414.08	0.11%	77,364,000.00	1.86%	-	-
兴业证券	-	-	491,000,000.00	11.78%	-	-
国信证券	20,016,975.40	4.33%	481,000,000.00	11.54%	-	-
中金公司	80,122,286.22	17.33%	868,800,000.00	20.85%	-	-
招商证券	115,910,867.31	25.07%	63,240,000.00	1.52%	-	-
国金证券	1,649,247.41	0.36%	2,066,000,000.00	49.58%	-	-
中信证券	-	-	30,000,000.00	0.72%	-	-

华安基金管理有限公司

二〇一七年三月二十八日